BANCO DE ESPAÑA **Sistemas de Información**

CONSULTA DE ANOTACIONES EN CUENTA

ANEXO 6

MANUAL DE USUARIO DE ENTIDADES. I.E. 93.03
JUNIO 2003

INDICE

1. Introducción..... 1
2. Descripción detallada. 2
2.1. Menú de consulta de anotaciones en cuenta. 2
2.2. Características de subastas en curso. 3
2.3. Resolución de las subastas en curso. 7
2.4. Peticiones adjudicadas. 10
2.5. Características de emisión de los códigos de valor dados de alta en la Central de Anotaciones. 12
2.6. Menú de consultas en tiempo real. 24
2.6.1. Detalle de operaciones. 25
2.6.2. Consulta en pantalla. 27
2.6.3. Saldos disponibles. 30

ÍNDICE DE PANTALLAS

CATM058 – Características de las subastas. 4
CATM05C1 – Condiciones generales y de remuneración. 15
CATM05C2 – Condiciones de amortización – 1 - 17
CATM05C3 – Condiciones de amortización – 3 - 20
CATM05C4 – Condiciones de amortización – 2 - 18
CATM05KV – Condiciones de segregación/reconstitución. 21
CATM1E1 – Selección de codigos de valor. 3
CATM1E4 – Peticiones adjudicadas. 10
CATM1E6 – Resolución de la subasta. 7
CATM1E7 – Resolución de la subasta por diferenciales. 8
CATM1E8 – Selección de códigos de valor dados de alta en la Central de Anotaciones. 14
CATM1E8E– Selección de códigos de emisor. 13
CATM1E8S – Selección de tipos de deuda 12
CATM340 – Menú de consultas en tiempo real. 24
CATM341 – Selección de operaciones a consultar. 25
CATM3411 – Detalle de operaciones por pantalla. 27
CATM342 – Saldos disponibles. 30
MAPA1230 – Menú de consulta de anotaciones en cuenta. 2

ÍNDICE DE TRANSACCIONES

UO07 – Características de subastas en curso. 3
UO17 – Resolución de las subastas en curso..... 7
UO18 – Características de emisión de los códigos de valor en la Central de Anotaciones. 12
UO27 – Peticiones adjudicadas. 10
UO34 – Menú de consulta de anotaciones en cuenta. 2

1. Introducción.

Mediante la transacción **UO34** se puede conocer las características de códigos de valor dados de alta en la Central de Anotaciones, salvo los ya amortizados, las características de subastas en curso, los resultados de la resolución de dichas subastas, las peticiones que han sido adjudicadas a la entidad o la situación de las operaciones asimiladas por el sistema en cualquier momento.

2. Descripción detallada.

2.1. Menú de consulta de anotaciones en cuenta.

UO34 – Menú de consulta de anotaciones en cuenta.

A través del menú general de entidades **UJ99,** de la opción 3 de la **UJ00** o bien tecleando directamente **UO34** accedemos a la pantalla:

MAPA1230 – Menú de consulta de anotaciones en cuenta.

```
UO34          MENU DE CONSULTA DE ANOTACIONES EN CUENTA          -OPCION 1.2.3-


 SELECCIONE UNA OPCION Y PULSE INTRO


  _  1.- CARACTERISTICAS DE LAS SUBASTAS EN CURSO
     2.- RESOLUCION DE LAS SUBASTAS EN CURSO
     3.- PETICIONES ADJUDICADAS
     4.- CARACTERISTICAS EMISION COD.VALOR DADOS DE ALTA EN CENTRAL ANOTACIONES
     5.- SITUACION DE OPERACIONES VALOR DIA EN CUENTAS DE VALORES









 MANDATO DIRECTO=
 F2= FIN  F11= MENU INICIAL   F12= MENU ANTERIOR
```

En dicho menú se presentan las opciones siguientes:

"1" - CARACTERÍSTICAS DE LAS SUBASTAS EN CURSO (UO07).
"2" - PRESOLUCIÓN DE LAS SUBASTAS EN CURSO (UO17).
"3" - PETICIONES ADJUDICADAS (UO27).
"4" - CARACTERÍSTICAS DE EMISION DE CODIGOS DE VALOR DADOS DE ALTA EN LA CENTRAL DE ANOTACIONES (UO18).
"5"- SITUACIÓN DE OPERACIONES VALOR DIA EN CUENTAS DE VALORES (OO34).

Al teclear la opción y pulsando **INTRO**, se continúa con la opción seleccionada.

Otras teclas de función activas son:

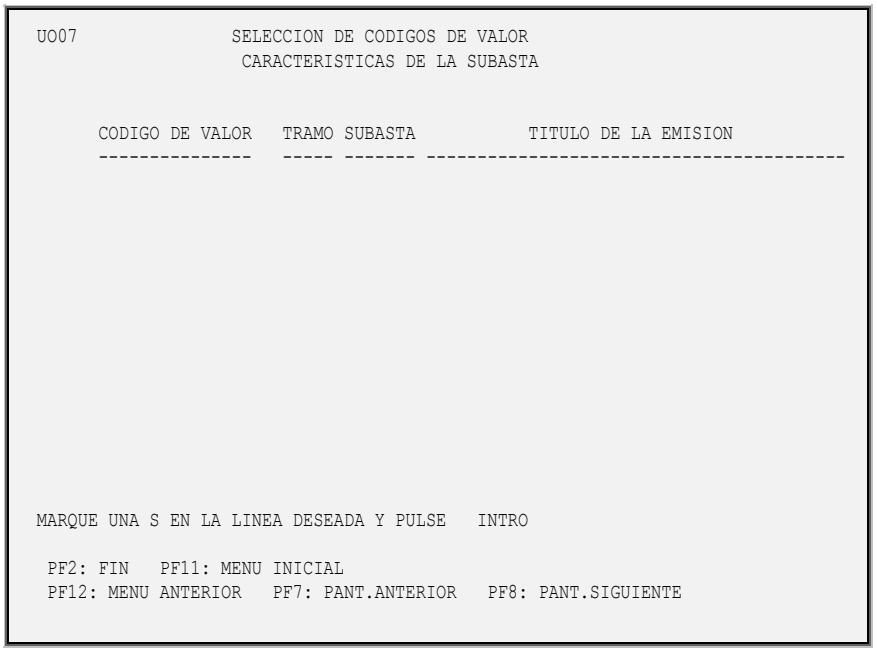
PF2 para terminar la transacción
PF11 para ir al menú inicial.
PF12 para ir al menú anterior.

2.2. Características de subastas en curso.

UO07 – Características de subastas en curso.

A través del menú general de entidades **UJ99** o bien tecleando directamente **UO07** se accede en primer lugar a la pantalla CATM1E1, que presenta los códigos de valor de las subastas que están en período de suscripción, o que van a ser emitidas en un futuro próximo.

CATM1E1 – Selección de codigos de valor.


UO07 SELECCION DE CODIGOS DE VALOR
CARACTERISTICAS DE LA SUBASTA
CODIGO DE VALOR TRAMO SUBASTA TITULO DE LA EMISION
MARQUE UNA S EN LA LINEA DESEADA Y PULSE INTRO
PF2: FIN PF11: MENU INICIAL
PF12: MENU ANTERIOR PF7: PANT.ANTERIOR PF8: PANT.SIGUIENTE

En la cabecera de la pantalla se muestra la transacción y opción seleccionadas. En este caso UO07, "CARACTERISTICAS DE LAS SUBASTAS EN CURSO".

Para cada una de las emisiones, aparece una línea en la pantalla con sus datos identificativo

CODIGO DE VALOR
TRAMO
NUMERO SUBASTA
TITULO DE LA EMISION

Para seleccionar el código de valor que se desea consultar, se debe marcar con una "S" la línea, y pulsar **INTRO**.

Otras teclas de función activas son:

PF2 para terminar la transacción
PF7 aparecen en pantalla los códigos de valor visualizados anteriormente.
PF8 aparecen en pantalla los siguientes códigos de valor a visualizar.
PF11 para ir al menú inicial.
PF12 para ir al menú anterior.

La pantalla de consulta de características de la subasta, tiene el siguiente formato:

CATM058 – Características de las subastas.

```
U007 8  CAT-CENTRAL DE ANOTACIONES - DATOS INFORMATIVOS DE EMISION. TITULARES

       CODIGO VALOR :              TITULO DEL TRAMO:
       TRAMO        :              XXXXXXXXXXXXXXXXXX EX- UPON IMPORTE
       SUBASTA      :
       IMPORTE CUPON EN SUBASTA CON PRECIO EX-CUPON         :

       SOLICITUD DE PETICIONES PARA LA SUBASTA              :
              - HORARIO DE ENTRADA DE DATOS           : DE           A
       RESOLUCION DE LA SUBASTA                             :
       POSIBLE PRORRATEO                                    :
       DESGLOSE DE PETICIONES A PRORRATEAR HASTA EL DIA     : NO HAY
              - HORARIO DE ENTRADA DE DATOS           : DE           A
       DESGLOSE DE PETICIONES ADJUDICADAS HASTA EL DIA      :
       COMPLETAR DATOS TERCEROS EN OTRAS GESTORAS HASTA     :
       ADEUDO EN CUENTA DE TESORERIA DE LA EMISION          :
       ABONO DE LA COMISION                                 :
       ABONO DE LA EMISION EN LA CENTRAL DE ANOTACIONES     :
              - EN CASO DE PRORRATEO                        :
       ABONO DE PETICIONES DOMICILIADAS EN OTRAS GESTORAS   :
 NORMATIVA:
 AVISOS   :

  PF2: FIN   PF3: MENU ANTERIOR   PF7: PANTALLA ANTERIOR   PF12: ANULACION
```

El contenido y significado de los campos es el siguiente:

* CODIGO DE VALOR:

* TRAMO:

* SUBASTA:

* TITULO DE LA EMISION:

Campos no modificables. Contienen los valores tecleados en la pantalla anterior.

* IMPORTE CUPON:

Campo no modificable. Cuando las ofertas competitivas tienen que formularse mediante precio ex_cupón, informa del cupón corrido que, expresado en porcentaje, ha se devenga desde la fecha de puesta en circulación del tramo objeto de subasta hasta el vencimiento del próximo cupón.

* SOLICITUD DE PETICIONES PARA LA SUBASTA:

Fecha de presentación de peticiones para la subasta.

* HORARIO DE ENTRADA DE DATOS:

Horario durante el cual se pueden introducir peticiones para la subasta.

* RESOLUCION DE LA SUBASTA:

Día en el que se resuelve la subasta.

* POSIBLE PRORRATEO:

En caso de que haya lugar a prorrateo, fecha del mismo.

* DESGLOSE DE PETICIONES A PRORRATEAR HASTA EL DIA:

En caso de que haya lugar a prorrateo, fecha límite para introducir el desglose de peticiones globales sujetas a prorrateo.

* HORARIO DE ENTRADA DE DATOS:

Horario durante el cual se puede realizar la entrada de datos de desgloses para prorrateo.

* DESGLOSE DE PETICIONES ADJUDICADAS HASTA EL DIA:

Ultimo día de presentación por parte de los peticionarios, del desglose de peticiones para comunicación de depositarios.
En caso de no introducir desgloses, las peticiones presentadas por entidades titulares se abonarán a la propia entidad.

* COMPLETAR DATOS DE TERCEROS EN OTRAS GESTORAS HASTA:

Ultimo día para completar los datos de los titulares de peticiones de terceros que van a ser depositadas en otra entidad titular diferente de la presentadora.

* ADEUDO EN LA CUENTA DE TESORERIA DE LA EMISION:

Día en que se adeudan en las cuentas de tesorería los importes efectivos correspondientes a los nominales suscritos.

* ABONO DE LA COMISION:

Día en que se abonan los efectivos por pago de comisión a los titulares de cuenta.

* ABONO DE LA EMISION EN LA CENTRAL DE ANOTACIONES:

Si no hay prorrateo, en esta fecha se realizará el abono de las adjudicaciones en la Central de Anotaciones.

* ABONO DE LA EMISION EN CASO DE PRORRATEO:

Si hay prorrateo, en esta fecha se realizará el abono de las adjudicaciones en la Central de Anotaciones.

* ABONO DE PETICIONES DOMICILIADAS EN OTRAS GESTORAS:

En caso de que la entidad presentadora no coincida con la entidad depositaria, el abono de los nominales adjudicados se lleva a cabo, de forma transitoria, en la cuenta 9994. En esta fecha se efectúan los traspasos de dicha cuenta a las de las entidades depositarias, según el desglose de los presentadores.

* NORMATIVA:

Texto informativo referente a la normativa establecida para la presentación y abono de peticiones.

* AVISOS:

Otro texto informativo.

Otras teclas de función activas son:

PF2 para ir a la pantalla CATM1E1, de selección de códigos de valor.

PF3 para ir a la pantalla de selección anterior.

2.3. Resolución de las subastas en curso.

UO17 – Resolución de las subastas en curso.

Una vez resuelta la subasta, las entidades disponen de una pantalla de consulta con el resultado de la misma. Para ello, pueden entrar a través del menú general de entidades **UJ99** o bien teclear directamente **UO17**; en ambos casos se accede en primer lugar a la pantalla CATM1E1, que presenta los códigos de valor de las subastas que ya han sido resueltas, y aún no han sido abonadas en la central de anotaciones.

En el caso de subastas que no son por diferenciales, tras seleccionar el código de valor a tratar aparece la pantalla que se muestra a continuación:

CATM1E6 – Resolución de la subasta.

```
CAT-CENTRAL DE ANOTACIONES - RESOLUCION DE LA SUBASTA. TITULARES


                      CODIGO VALOR : XXXXXXXXXXXX
                      TRAMO        : 99
                      SUBASTA      : 9

                XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX

         NOMINAL SOLICITADO                     : 0
         NOMINAL ADJUDICADO                     : 0
         PRECIO MINIMO ACEPTADO                 : 0,000        %
         PRECIO MEDIO PONDERADO REDONDEADO      : 0,000        %
         TIPO DE INTERES MARGINAL               : 0,000        %
         TIPO DE INTERES MEDIO                  : 0,000        %
         COEFICIENTE DE PRORRATEO               : 0,00         %
           - MINIMO EXENTO EN CASO DE PRORRATEO  : 0




  PF2: FIN   PF3: MENU ANTERIOR
```

El contenido y significado de los campos de esta pantalla es el siguiente:

* Campos no modificables. Contienen los valores tecleados en la pantalla inicial.

    * CODIGO DE VALOR:

    * TRAMO:

    * NUMERO SUBASTA:

    * TITULO DE LA EMISION:

* Son campos de salida que contienen la información sobre la resolución de la subasta.

    * NOMINAL SOLICITADO:

    * NOMINAL ADJUDICADO:

    * PRECIO MINIMO ACEPTADO:

    * PRECIO MEDIO PONDERADO REDONDEADO:

    * TIPO DE INTERES MARGINAL:

* TIPO DE INTERES MEDIO:

* COEFICIENTE DE PRORRATEO:

* MINIMO EXENTO EN CASO DE PRORRATEO.

Otras teclas de función activas son:

PF2 para ir a la pantalla CATM1E1, de selección de códigos de valor.

PF3 para ir a la pantalla de selección anterior.

En el caso de subastas por diferenciales, tras seleccionar el código de valor a tratar aparece la pantalla que se muestra a continuación:

CATM1E7 – Resolución de la subasta por diferenciales.

```
UO17   CAT-CENTRAL DE ANOTACIONES - RESOLUCION DE LA SUBASTA. TITULARES


                      CODIGO VALOR : XXXXXXXXXXXX
                      TRAMO        : 99
                      SUBASTA      : 9

                  XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX

             NOMINAL SOLICITADO       : 0
             NOMINAL ADJUDICADO       : 0
             DIFERENCIAL MARGINAL     : 0,000  %
             DIF.MEDIO.POND.REDONDEADO: 0,000  %
             PRIMER DIF. NO ACEPTADO  : 0,000  %
             NOMINAL ADJ. AL MARGINAL : 0

             PRECIO MARGINAL          : 0,000  %
             PRECIO MEDIO POND. REDON.: 0,000  %
             INTERES MARGINAL         : 0,000  %
             INTERÉS MEDIO POND.REDON.: 0,000  %
             COEFICIENTE DE PRORRATEO : 0,000  %


  PF2: FIN   PF3: MENU ANTERIOR
```

El contenido y significado de los campos de esta pantalla es el siguiente:

* Campos no modificables. Contienen los valores tecleados en la pantalla inicial.

    * CODIGO DE VALOR:

    * TRAMO:

    * NUMERO SUBASTA:

    * TITULO DE LA EMISION:

* Campos de salida que contienen la información sobre la resolución de la subasta.

    * NOMINAL SOLICITADO:

    * NOMINAL ADJUDICADO:

* DIFERENCIAL MARGINAL:

* DIFERENCIAL MEDIO PONDERADO REDONDEADO:

* PRIMER DIFERENCIAL NO ACEPTADO:

* NOMINAL A ADJUDICAR AL MARGINAL:

* PRECIO MARGINAL:

* COEFICIENTE DE PRORRATEO:

* Campos de salida que contienen la información sobre el precio y el interés una vez conocido el referente.

* PRECIO MEDIO PONDERADO REDONDEADO:

* INTERES MARGINAL:

* INTERES MEDIO PONDERADO REDONDEADO:

Otras teclas de función activas son:

PF2 para ir a la pantalla CATM1E1, de selección de códigos de valor.

PF3 para ir a la pantalla de selección anterior.

2.4. Peticiones adjudicadas.

UO27 – Peticiones adjudicadas.

Una vez resuelta la subasta, las entidades pueden consultar la adjudicación de sus peticiones. Para ello, pueden entrar a través del menú general de entidades **UJ99** o bien teclear directamente **UO27**; en ambos casos, se accede en primer lugar a la pantalla CATM1E1, que presenta los códigos de valor de las subastas que ya han sido adjudicadas y que aún no han sido abonadas a la central de anotaciones, y tras seleccionar el código de valor a tratar aparece la pantalla que se muestra a continuación.

CATM1E4 – Peticiones adjudicadas.

```
  UO27 1                 PETICIONES ADJUDICADAS
                           NOMINALES EN EUROS
         CODIGO VALOR: XXXXXXXXXXX TRAMO: 99   SUBASTA:  9
         XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX
    ENTIDAD   TIPO    NOMINAL(MILLS.)    PRECIO/TIPO              DATOS OTROS
   PRESENTAD. PET.     ADJUDICADO        ADJUDICADO               DEPOSITARIOS
   ---------- ---- --------------------  -----------  ----------  ------------









TOTAL PET. COMPET....:
           NO COMPET.:

 PF2: SELEC. CODIGOS   PF3: MENU ANTERIOR   PF7: PANT.ANTER.    PF8: PANT.SIGU.
```

El contenido y significado de los campos de esta pantalla es el siguiente:

* Campos no modificables. Contienen los valores tecleados en la pantalla inicial.

    * CODIGO DE VALOR:

    * TRAMO:

    * NUMERO SUBASTA:

    * TITULO DE LA EMISION:

* Son campos de salida que contienen la información sobre la adjudicación de cada una de las peticiones.

    * ENTIDAD:

    * TIPO PETICIÓN:

    * NOMINAL ADJUDICADO:

    * PRECIO/TIPO ADJUDICADO:

* T.I.R.:

* DATOS OTROS DEPOSITARIOS:

Es un campo de salida donde se informa de la situación de la petición, en lo que se refiere a depositarios.
Los posibles valores son:

SD: SIN DATOS.
CD: DATOS CORRECTOS.
IC: FALTA COMPLETAR DATOS DE TERCEROS.

* TOTALES DE PETICIONES COMPETITIVAS Y NO COMPETITIVAS:

Recogen los acumulados del número de peticiones y la suma de los nominales vivos de todas las peticiones.

Otras teclas de función activas son:

PF2 para ir a la pantalla CATM1E1, de selección de códigos de valor.

PF3 para ir a la pantalla de selección anterior.

PF7 aparece en pantalla las peticiones visualizadas anteriormente.

PF8 aparece en pantalla las peticiones siguientes a consultar.

2.5. Características de emisión de los códigos de valor dados de alta en la Central de Anotaciones.

UO18 – Características de emisión de los códigos de valor en la Central de Anotaciones.

A través del menú general de entidades **UJ99** o bien tecleando directamente **UO18** se accede en primer lugar a la pantalla CATM1E8S, que presenta los tipos de deuda pública y privada con su descripción.

CATM1E8S – Selección de tipos de deuda

```
       SELECCION DE TIPOS DE DEUDA

 MARQUE UNA  'S'  EN LA LINEA ELEGIDA, Y  PULSE   INTRO
 O TECLEE EL TIPO DE DEUDA QUE DESEA CONSULTAR:
 O TECLEE EL CODIGO ISIN QUE DESEA CONSULTAR  :
      TIPO DEUDA             TITULO DE LA DEUDA
      ----------       -------------------------------------
PF2: FIN   PF7: PANT.ANTERIOR   PF8: PANT.SIGUIENTE
```

En la cabecera de la pantalla se muestra la transacción y opción a seleccionar. En este caso UO18, “SELECCIÓN DE TIPOS DE DEUDA”.

Para cada tipo de deuda, aparece una línea en la pantalla con su descripción.

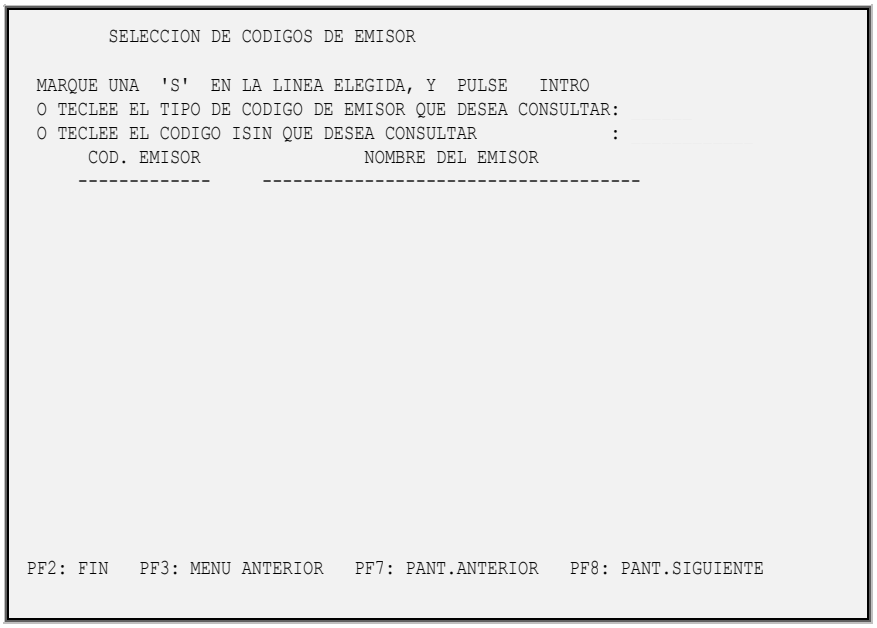
La consulta de las características de emisión de un determinado código valor se realiza al teclear dicho código de valor, en la línea donde dice “TECLEE EL CODIGO ISIN QUE DESEA CONSULTAR”, y pulsando **INTRO**. O bien al seleccionar mediante la letra “S” uno de los tipos de deuda presentados en pantalla, o tecleándolo en la línea donde dice “TECLEE EL TIPO DE DEUDA QUE DESEA CONSULTAR” y pulsando **INTRO**, con lo que se muestra la pantalla de consulta de los emisores que pueden emitir el tipo de deuda seleccionado.

Otras teclas de función activas son:

PF2 para terminar la transacción.
PF7 aparecen los códigos de valor anteriormente visualizados.
PF8 aparecen los siguientes códigos de valor a visualizar.
PF11 para salir de la transacción.
PF12 para salir de la transacción.

La pantalla de consulta de los emisores que pueden emitir el tipo de deuda seleccionada en la pantalla anterior tiene el siguiente formato.

CATM1E8E– Selección de códigos de emisor.


SELECCION DE CODIGOS DE EMISOR
MARQUE UNA 'S' EN LA LINEA ELEGIDA, Y PULSE INTRO
O TECLEE EL TIPO DE CODIGO DE EMISOR QUE DESEA CONSULTAR:
O TECLEE EL CODIGO ISIN QUE DESEA CONSULTAR :
COD. EMISOR NOMBRE DEL EMISOR
PF2: FIN PF3: MENU ANTERIOR PF7: PANT.ANTERIOR PF8: PANT.SIGUIENTE

En la cabecera de la pantalla se muestra la transacción y opción seleccionada, UO18 “SELECCIÓN DE CODIGOS DE EMISOR”.

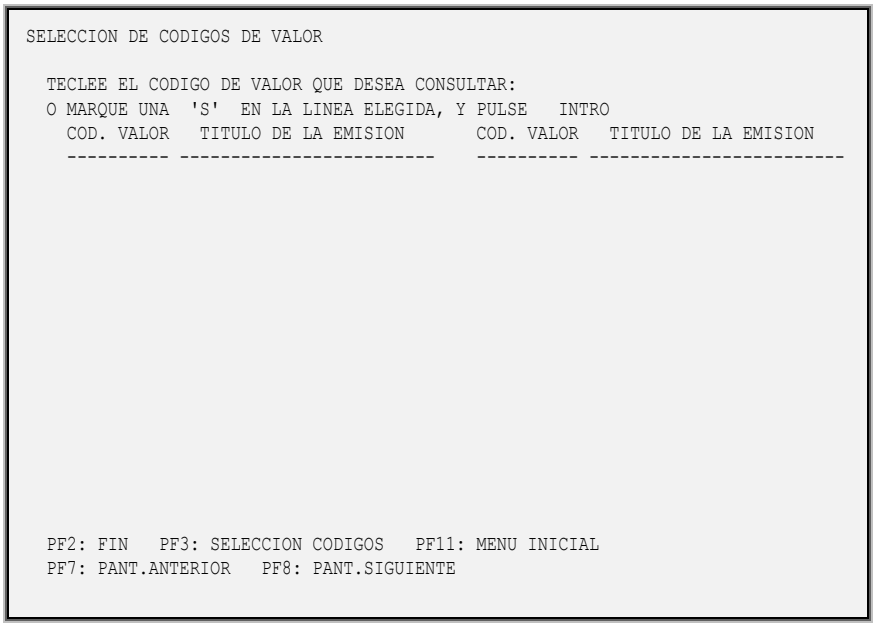
Para cada código de emisor, aparece una línea con su descripción.

La consulta de las características de emisión de un determinado código de valor se realiza al teclear dicho código de valor, en la línea donde dice “TECLEE EL CODIGO ISIN QUE DESEA CONSULTAR”, y pulsando **INTRO**. O bien al seleccionar mediante la letra “S” uno de los códigos de emisor presentados y pulsando **INTRO** accedemos a la pantalla de selección de los códigos de valor.

Otras teclas de función activas son:

PF2 para terminar la transacción.
PF7 aparecen los códigos de valor anteriormente visualizados.
PF8 aparecen los siguientes códigos de valor a visualizar.
PF3 para acceder a la pantalla anterior.

CATM1E8 – Selección de códigos de valor dados de alta en la Central de Anotaciones.


SELECCION DE CODIGOS DE VALOR
TECLEE EL CODIGO DE VALOR QUE DESEA CONSULTAR:
O MARQUE UNA 'S' EN LA LINEA ELEGIDA, Y PULSE INTRO
COD. VALOR TITULO DE LA EMISION
COD. VALOR TITULO DE LA EMISION
PF2: FIN PF3: SELECCION CODIGOS PF11: MENU INICIAL
PF7: PANT.ANTERIOR PF8: PANT.SIGUIENTE

En la cabecera de la pantalla se muestra la transacción y opción seleccionadas. En este caso UO18, "CARACTERISTICAS DE EMISION DE CODIGOS DE VALOR".

Para cada código de valor, aparece una línea en la pantalla con sus datos identificativos:

CODIGO DE VALOR
TITULO DE LA EMISION

La consulta de las características de emisión de un determinado código de valor se realiza al teclear dicho código de valor, en la línea donde dice "TECLEE EL CODIGO DE VALOR QUE DESEA CONSULTAR", y pulsando **INTRO**, o bien al seleccionar mediante con la letra "S" uno de los códigos de valor presentados en pantalla y pulsando **INTRO**.

Otras teclas de función activas son:

PF2 para terminar la transacción.
PF7 aparecen los códigos de valor anteriormente visualizados.
PF8 aparecen los siguientes códigos de valor a visualizar.
PF11 para ir al menú inicial.
PF12 para ir al menú anterior.

La pantalla de consulta de características de emisión y condiciones de remuneración, tiene el siguiente formato:

CATM05C1 – Condiciones generales y de remuneración.

```
CAT-CENTRAL DE ANOTACIONES - CARACTERISTICAS GENERALES DE LA EMISION -1-

  CARACTERISTICAS EMISION
    CODIGO VALOR .........:
    TIPO DE DEUDA ........:
    TITULO ...............:
    ORGANISMO EMISOR .....:
    IMP. MIN. NEGOCIACION :
    STRIP DE CUPONES .....:   (S/N)
    EM. SUCESIVA COD .....:                AMORTIZACION REAL ...:
    FECHA DE EMISION .....:                AMORTIZACION TEORICA.:
    SALDO CIRCULACION ANOTACIONES EN CUENTA ........:
    NOTAS:


  CONDICIONES DE REMUNERACION
    VENCIMIENTOS DE CUPON ..:                                  (FORMATO: DDMM)

    FECHA DEVENGO 1ER. CUPON:              CUPON BRUTO:
    FECHA PAGO 1ER. CUPON ..:              CUPON NETO :
    FECHA VTO. PROXIMO CUPON:                           (EUROS)

   PF2: FIN  PF3: MENU ANTERIOR  PF8: PANTALLA SIGUIENTE
```

En la línea de CONDICIONES DE REMUNERACION aparece la leyenda **ADELANTA PAGO SI ES DIA NO HABIL** o **ATRASA PAGO SI ES DIA NO HABIL**, para indicar la decisión adoptada cuando la fecha de amortización o de vencimiento de cupón es día no hábil en Madrid.

Al lado del tipo de deuda se muestra el literal **PRIVADA** cuando se trata de deuda privada.

A continuación del código de valor, sólo para el caso de deuda privada, se muestra el literal **DEUDA SUSPENDIDA DE COTIZACION** cuando se dé dicha circunstancia y **NO ANOTACION EN CTA.** cuando el activo esté emitido en títulos.

Debajo de la fecha de Vto. Próximo cupón, sólo para el caso de deuda privada, aparece la frase **PAGO DE CUPON POR TITULO** o **PAGO DE CUPON POR SALDO** que indica que si el pago de cupones es por títulos o por saldo.

Debajo de la línea del IMPORTE BRUTO se muestra la frase **DEUDA SIN CUPONES**, cuando se trata de una deuda sin cupones.

El contenido y significado de los campos es el siguiente:

* CODIGO DE VALOR:

Código de valor de la emisión.

* TIPO DE DEUDA:

Denominación de la deuda.

* TITULO:

Denominación de la emisión.

* ORGANISMO EMISOR:

Denominación del Organismo emisor.

* UNID.EMISION.INICIAL:

Nominal de cada título.

* STRIP DE CUPONES:

Permite (S), no permite (N), tal operación.

* EM.SUCESIVA COD:

Cuando el código valor visualizado es fungible con otro, en este campo aparece dicho código de valor.

* FECHA EMISION:

Fecha de emisión de la deuda.

* AMORTIZACION REAL

Fecha en que se amortiza definitivamente el código de valor, ya sea por amortización final u opcional ejercida por el emisor.
En formato DDMMAAAA

* AMORTIZACION TEORICA

Fecha establecida para la amortización final en las condiciones iniciales del código de valor.
En formato DDMMAAAA

* NOTAS:

Observaciones destacables.

* VENCIMIENTOS DE CUPON:

Vencimientos de cupón que se producen en un año. Visualizados en formato día y mes.

* FECHA DEVENGO 1ER. CUPON:

Fecha comienzo del devengo del primer cupón.

* FECHA PAGO 1ER. CUPON:

Fecha correspondiente al pago del primer cupón.

* FECHA PROXIMO CUPON:

Fecha de vencimiento que corresponde al próximo cupón.

* CUPON BRUTO:

Importe bruto a pagar que corresponde al próximo cupón.

* CUPON NETO:

Importe neto a pagar que corresponde al próximo cupón.

Otras teclas de función activas son:

PF2 para ir a la pantalla CATM1E1, de selección de códigos de valor.
PF3 para ir a la pantalla de selección anterior.
PF8 para acceder a la pantalla siguiente a visualizar.

La pantalla de consulta de condiciones de amortización opcionales, tiene el siguiente formato:

CATM05C2 – Condiciones de amortización – 1 -

```
UO18 CAT-CENTRAL DE ANOTACIONES - CARACTERISTICAS GENERALES DE LA EMISION -2-
  CODIGO VALOR .:              PRIMA AMORTIZACION FINAL REAL                 %
                                 '         '        '   TEORICA              %
  AMORTIZACIONES OPCIONALES
   FECHA    O  PRIMA EMIS.%    PRIMA TENE.%   EJERCE EMISOR (S/N - FECHA)
  01032001  E     4,0000000
  01032002  T                    3,0000000
  01032003  A     2,0000000      1,0000000
  PF2: FIN  PF3: MENU ANTERIOR  PF7: PANTALLA ANTERIOR  PF8: PANTALLA SIGUIENTE
```

El contenido y significado de los campos es el siguiente:

* CODIGO DE VALOR:

  Código de valor ISIN.

* PRIMA AMORTIZACION FINAL REAL:

  Importe, tanto por ciento sobre el nominal, de la prima de amortización final real. Inicialmente se le asigna el valor de la prima de amortización final teórica, si el emisor ejerce la opción de amortización opcional se sustituye por la prima correspondiente al emisor en dicha amortización opcional.

* PRIMA AMORTIZACION FINAL TEORICA:

  Importe, tanto por ciento sobre el nominal, de la prima de amortización final teórica establecida al inicio de la emisión.

* AMORTIZACIONES OPCIONALES:

  Si no existe información sobre este tipo de amortización, aparece la siguiente leyenda: **NO EXISTE INFORMACION DISPONIBLE**.
  En caso contrario el mapa presenta los siguientes campos:

* FECHA:

  Fecha de amortización opcional.

* EJERCE LA OPCION (O):

A efectos informativos, quién puede ejercer la opción de amortización opcional: 'é', el emisor; 'T', el tenedor; 'á', ambos. Este campo, con valor inicial "E" o "A", se cambia a "T" cuando el emisor decida no ejercerla. Por contra, si la ejerce, la amortización pasa a ser amortización final.

* PRIMA EMIS.%:

Importe, tanto por ciento sobre el nominal, de la prima de amortización opcional si el emisor ejerce la opción de amortización.

* PRIMA TENE.%:

Importe, tanto por ciento sobre el nominal, de la prima de amortización opcional si el tenedor ejerce la opción de amortización.

* EJERCE EMISOR (S/N - FECHA):

A efectos informativos, indica si el emisor ejercita o no la opción de amortización y la fecha de tal decisión. Este campo, sin valor inicial se cambia a "S" o "N" cuando el emisor decida ejercer o no ejercer, respectivamente, la opción de amortización.

Otras teclas de función activas son:

PF2 para ir a la pantalla CATM1E1, de selección de códigos de valor.

PF3 para ir a la pantalla de selección anterior.

PF7 aparece la pantalla anteriormente visualizada.

PF8 para acceder a la pantalla siguiente a visualizar.

La pantalla de consulta de condiciones de amortización proporcionales, tiene el siguiente formato:

CATM05C4 – Condiciones de amortización – 2 -

```
 UO05 CAT-CENTRAL DE ANOTACIONES - CONDICIONES DE AMORTIZACION
 CODIGO VALOR  : 0000195235

CALCULO POR TITULO :    (S/N)
ANOTACION EN CUENTA:    (S/N)

AMORTIZACIONES PROPORCIONALES:      AUTORIZADA CONSULTA A ENTIDADES: s  (S/N)

      FECHA      IMPORTE UNITARIO A REDUCIR     FACTOR        PRIMA %
     01072000                                  01 004         10,0000000









?PF2:FIN PF3:MENU ANT  PF6:CONF PF7:PANT ANT  PF8:PANT SIG  PF12:ANULACION

CATN052215: DATOS INICIALES.
```

El contenido y significado de los campos es el siguiente:

* CODIGO DE VALOR:

  Código de valor ISIN.

* AMORTIZACIONES PROPORCIONALES:

  Si no existe información sobre este tipo de amortización, aparece la siguiente leyenda: **NO EXISTE INFORMACION DISPONIBLE**.
  En caso contrario el mapa presenta los siguientes campos:

* FECHA:

  Fecha de amortización proporcional.

* IMPORTE UNITARIO:

  Importe que se reduce al aplicar la amortización por reducción de nominal cuando el tratamiento del activo es por títulos.

* FACTOR:

  Numerador y denominador de la fracción de nominal a amortizar cuando el tratamiento del activo es por saldos..

* PRIMA %:

  Importe, tanto por ciento sobre el nominal, de la prima de amortización proporcional.

Otras teclas de función activas son:

PF2 para ir a la pantalla CATM1E1, de selección de códigos de valor.

PF3 para ir a la pantalla de selección anterior.

PF7 aparece la pantalla anteriormente visualizada.

PF8 para acceder a la pantalla siguiente a visualizar.

La pantalla de consulta de condiciones de amortización anticipadas y por canje, tiene el siguiente formato:

CATM05C3 – Condiciones de amortización – 3 -

```
CAT-CENTRAL DE ANOTACIONES - CARACTERISTICAS GENERALES DE LA EMISION -2-
  CODIGO VALOR .: L097012330


  AMORTIZACIONES ANTICIPADAS
   FECHA    PRECIO %   FECHA    PRECIO %   FECHA    PRECIO %   FECHA    PRECIO %
  12061996   1,10000




  AMORTIZACIONES POR CANJE
       FECHA         CODIGO VALOR     PRECIO %       CODIGO VALOR     PRECIO %
      02071997









   PF2: FIN  PF3: MENU ANTERIOR  PF7: PANTALLA ANTERIOR
```

El contenido y significado de los campos es el siguiente:

* CODIGO DE VALOR:

Código de valor ISIN.

* AMORTIZACIONES ANTICIPADAS:

Si no existe información sobre este tipo de amortización, aparece la siguiente leyenda: **NO EXISTE INFORMACION DISPONIBLE**.
En caso contrario el mapa presenta los siguientes campos:

* FECHA:

Fecha de amortización anticipada.

* PRECIO:

Precio al que se amortizan los importes nominales.

* AMORTIZACIONES POR CANJE:

Si no existe información sobre este tipo de amortización, aparece la siguiente leyenda: **NO EXISTE INFORMACION DISPONIBLE**.
En caso contrario el mapa presenta los siguientes campos:

* FECHA:

Fecha en la cual se produce el canje.

* CODIGO DE VALOR:

Código de la emisión y tramo de cada una de las posibles emisiones por la que se canjea la emisión antigua.

* PRECIO:

Precio de amortización según canje.

Otras teclas de función activas son:

PF2 para ir a la pantalla CATM1E1, de selección de códigos de valor.

PF3 para ir a la pantalla de selección anterior.

PF7 aparece la pantalla anteriormente visualizada.

PF8 solo está activa para deuda sujeta a strip de cupones, (bonos segregables, principal segregado y cupones segregados), y en este caso se accede a la siguiente pantalla a visualizar.

La pantalla de consulta de condiciones de segregación y reconstitución sólo aparece en los casos de deuda sujeta a strip de cupones y tiene el siguiente formato:

CATM05KV – Condiciones de segregación/reconstitución.

```
. CAT-CENTRAL DE ANOTACIONES - CONDICIONES DE SEGREGACION/RECONSTITUCION



  CODIGO VALOR :
  TIPO DE DEUDA :

  NOMINAL ACTUAL     :                  CODIGO VALOR COMPLETO:
  NOMINAL SEGREGADO :                             /PRINCIPAL
  UNIDAD SEGREGACION :

                       CODIGOS DE VALOR CUPONES/COMPLETOS
  ------------------------------------------------------------------------------









  PF2: FIN   PF3: MENU ANTERIOR   PF6: CONFIRMAR   PF12: ANULAR
```

Si no existe información sobre el STRIP de cupones, aparece la siguiente leyenda: **NO EXISTE INFORMACION DISPONIBLE**.

En caso contrario el mapa presenta los siguientes campos:

* CODIGO DE VALOR:

Código de valor ISIN.

* TIPO DE DEUDA:

Código del tipo de deuda al que corresponde el código valor consultado. Los posibles tipos de deuda son:

DST: Bonos segregables
NDP: Nuda propiedad
CUP: Cupones segregados

* NOMINAL ACTUAL:

Importe nominal en anotaciones para el código valor consultado. Si dicho código valor corresponde al tipo de deuda DST (Bonos segregables), este nominal es el que ha sido emitido y no ha sido segregado ni amortizado.
Para el resto de códigos valor, NDP (principal) y CUP (cupones), se trata del nominal total que hay en ese momento y que proviene exclusivamente de la segregación de Bonos segregables.

* NOMINAL SEGREGADO:

Importe nominal que ha sido segregado en principal y cupones. Sólo tiene contenido para Bonos segregables.

* UNIDAD DE Segregación:

Nominal unitario necesario para las operaciones de segregación y reconstitución. No tiene contenido para códigos valor del tipo de deuda CUP (cupones segregados), ya que al ser fungibles los cupones segregados de distintos Bonos que tienen la misma fecha de amortización, la unidad de segregación puede ser diferente dependiendo del código completo del que proceda el cupón.

* CODIGO VALOR COMPLETO/PRINCIPAL:

Tanto el literal que aparece en la pantalla como el contenido del campo es diferente según el tipo de deuda del código valor consultado.

- Tipo de deuda DST (Bono segregable):
Aparece en la pantalla el literal "PRINCIPAL" y el contenido del campo corresponde al código valor de la nuda propiedad que tiene asociado el Bono al realizar un strip de cupones.

- Tipo de deuda NDP (Nuda propiedad):
Aparece en la pantalla el literal "COMPLETO" y el contenido del campo corresponde al código valor del Bono segregable que tiene asociado en la operación de reconstitución de nuda propiedad y cupones en Bonos.

- Tipo de deuda CUP (Cupones segregados):
No tiene contenido.

* CODIGO VALOR CUPONES/COMPLETO:

Tanto el literal que aparece en la pantalla como el contenido del campo es diferente según el tipo de deuda del código valor consultado.

- Tipo de deuda DST (Bono segregable):
Aparece en la pantalla el literal "CUPONES" y el contenido del campo corresponde a una tabla de códigos valor de Cupones segregados, que son aquellos en los que se segrega el Bono en una operación de strip de cupones.

- Tipo de deuda NDP (Nuda propiedad):
Aparece en la pantalla el literal "CUPONES" y el contenido del campo corresponde asimismo a una tabla de códigos valor de cupones segregados, que son aquellos con los que se tiene que

agregar para realizar una operación de reconstitución en bonos segregables.

- Tipo de deuda CUP (Cupones segregados):
Aparece en la pantalla el literal "COMPLETOS" y el contenido del campo corresponde a una tabla de códigos valor de bonos segregables, en cada uno de los cuales podría realizar una operación de reconstitución.

Otras teclas de función activas son:

PF2 para ir a la pantalla CATM1E1, de selección de códigos de valor.

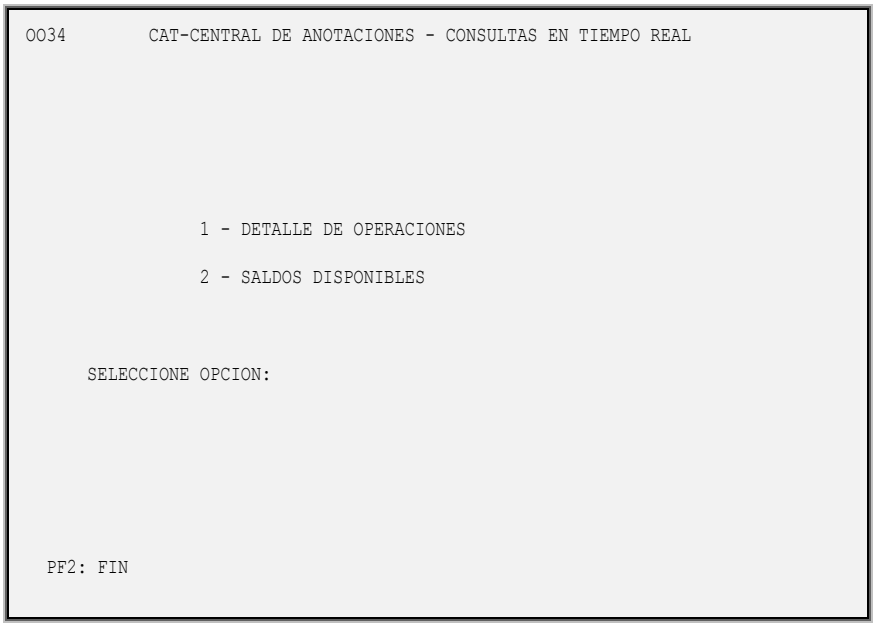
PF3 para ir a la pantalla de selecciona anterior.

PF7 aparece la pantalla anteriormente visualizada.

2.6. Menú de consultas en tiempo real.

A través del menú general de entidades **UJ99** o bien tecleando directamente **OO34** accedemos al menú de consultas en tiempo real:

CATM340 – Menú de consultas en tiempo real.


OO34 CAT-CENTRAL DE ANOTACIONES - CONSULTAS EN TIEMPO REAL
1 - DETALLE DE OPERACIONES
2 - SALDOS DISPONIBLES
SELECCIONE OPCION:
PF2: FIN

Hay dos opciones disponibles:

Seleccionando la opción 1, se accederá a la consulta de las operaciones en detalle.

Seleccionando la opción 2, se podrá consultar los saldos disponibles en tiempo real.

2.6.1. Detalle de operaciones.

A través de la opción 1 del menú de consultas en tiempo real, se accederá a la consulta en detalle de las operaciones.

CATM341 – Selección de operaciones a consultar.

```
0034.1   CAT-CENTRAL DE ANOTACIONES - DETALLE DE OPERACIONES

                                            FECHA OPERACION:

  ENTIDADES:   (T/S)
             .... .... .... .... ....


  SELECCIONE TIPO DEUDA O CODIGO VALOR:

  - TIPO DE DEUDA....:   (T/S)
                       ... ... ... ... ...
  - CODIGO DE VALOR..: _ (T/S)
                       .......... .......... .......... .......... ..........
  - TIPO DE OPERACION:   (T/S)
                       .. .. .. .. ..
  - ESTADO OPERACION.:   (T=TODAS  D=DESCUBIERTOS  S=SIN ASENTAR)
                         (A=ASENTADAS  F=ASENTADAS EN FIRME)


  POR PANTALLA O IMPRESORA:   (P/I)

  PF2: FIN
```

El contenido y significado de los campos de esta pantalla es el siguiente:

* FECHA OPERACION:

Fecha de valor sobre la que se realiza la consulta, en formato DDMMAAAA.
Esta fecha es la fecha de proceso del Sistema CAT.
Campo no modificable.

* ENTIDAD:

Campo en el cual se indica la entidad que se desea consultar o sus asociadas. En caso de que se seleccione una "S", habrá que teclear de 1 a 5 códigos de Entidades válidos.
Campo modificable.

* TIPO DE DEUDA:

Campo en el cual se indica si se quiere consultar datos de todos los Tipos de Deuda o sólo de alguno determinado.
En caso de que se seleccione una "S", habrá que teclear de 1 a 5 Tipos de Deuda válidos.
La selección de este campo es incompatible con la de los Códigos de Valor.
Campo modificable.

* CODIGO DE VALOR:

Campo en el cual se indica si se quiere consultar datos de todos los Códigos de Valor o sólo de alguno determinado, en formato de 10 posiciones. En caso de que se seleccione una "S", habrá que teclear de 1 a 5 Códigos de Valor válidos.
La selección de este campo es incompatible con la de los Tipos de Deuda.
Campo modificable.

* TIPO DE OPERACION:

Campo en el cual se indica el tipo de operación que se desea consultar.
En caso de que se seleccione una "S", habrá que teclear de 1 a 5 tipos de operación.
Campo modificable.

* ESTADO DE LA OPERACION:

Campo en el cual se indica en que estado de tratamiento se encuentran las operaciones que deseamos consultar.
Existe la posibilidad de seleccionar operaciones en cualquier estado de tratamiento.
El significado de este campo es el siguiente: T=se listan todas las operaciones. D=se listan solo las operaciones que estén en descubierto. S=se listan las operaciones que estén en descubierto o sin tratar. A=se listan todas las operaciones asentadas. F=se listan las operaciones asentadas en firme.
Campo modificable.

* PANTALLA O IMPRESORA:

La Entidad conectada sólo podrá realizar la consulta por pantalla.

Al rellenar los datos de consulta obligatorios y pulsando **INTRO**, se realiza la consulta por pantalla.

Otras teclas de función activas son:

PF2 para terminar la transacción

PF3 para ir al menú anterior.

2.6.2. Consulta en pantalla.

Seleccionando una "P" en el campo "PANTALLA/IMPRESORA", rellenando los demás campos obligatorios y pulsando **INTRO** aparecerá la pantalla de consulta de operaciones.

CATM3411 – Detalle de operaciones por pantalla.

```
0034.1    CAT-CENTRAL DE ANOTACIONES - DETALLE DE OPERACIONES

ENTIDAD:                                          FECHA VALOR:
                                                                  PAG.
TIPO OPERAC. FECHA   NUM. ORDEN            E.C. FECHA
 COD. NOMBRE  CONTR.  STE   CAT  COD. VALOR BRK. RECOM.       NOMINAL       EST.
 ------------ ------ ---------- ---------- ---- ------ ------------------- ----









  PF2: FIN   PF3: MENU ANT.   PF7: PAG.ANT.   PF8: PAG.SIG.
```

El contenido y significado de los campos de esta pantalla es el siguiente:

* ENTIDAD:

Código y nombre de la Entidad que está realizando la consulta.
Campo no modificable.

* FECHA VALOR:

Fecha de valor sobre la que se realiza la consulta, en formato DDMMAAAA.
Campo no modificable. Contiene el valor obtenido en la pantalla anterior.

* PAGINA:

Número de página de la consulta que se está realizando.
Campo modificable.

* TIPO OPERACION - CODIGO:

Tabla de códigos de las operaciones que se están consultando.
Campo no modificable.

* TIPO OPERACION - NOMBRE OPERACION:

Nombre corto que identifica el tipo de operación. Campo no modificable.

* FECHA DE CONTRATACION:

Tabla de las Fechas de Contratación de las operaciones que se están consultando.
El formato de las fechas es DDMMAA Campo no modificable.

* NUMERO DE ORDEN:

Tabla de los números de orden de las operaciones que se están consultando.
El primer número que aparece es el número de orden según el STE (Servicio Telefónico) y el segundo es el asignado por el Sistema CAT.
Campo no modificable.

* CODIGO DE VALOR:

Tabla de los Códigos de Valor en formato de 10 posiciones de las operaciones que se están consultando.
Campo no modificable.

* ENTIDAD CONTRARIA/BROKER:

Tabla con los códigos de las Entidades contrarias a las operaciones que se están consultando.
En caso de usar Broker para realizar la operación, este campo contendrá el código del Broker.
Campo no modificable.

* FECHA DE RECOMPRA:

Tabla de las Fechas de Recompra de las operaciones que se están consultando.
El formato de las fechas es DDMMAA. Campo no modificable.

* NOMINAL:

Tabla con los nominales de las operaciones que se están consultando.
Si la operación consultada es una operación realizada por la entidad como compradora, el nominal de la operación aparecerá con signo positivo, en caso contrario, aparecerá con signo negativo.

Si el contenido del campo es "99.999.999.999.999" quiere decir que el nominal de la operación tiene más de 14 dígitos y no puede representarse por pantalla.
Campo no modificable.

* ESTADO:

Tabla con los literales correspondientes al estado en que se encuentran las operaciones que estamos consultando.
La correspondencia entre los literales y los estados es la siguiente:

"S.TR" → "SIN TRATAR"
"FIR1" → "ASENTADA EN FIRME EN EL PRIMER CICLO DE LIQUIDACION"
"FIR2" → "ASENTADA EN FIRME EN TIEMPO REAL"
"FIR3" → "ASENTADA EN FIRME EN EL CIERRE DE LA SESIÓN DE LIQUIDACIÓN"
"ASEN" → "ASENTADA EN VALORES"
"ANUL" → "ANULADA"
"DESC" → "DESCUBIERTO"
"D.TE" → "DESCUBIERTO BLOQUEOS TERCEROS"

Campo no modificable.

Otras teclas de función activas son:

PF2 para terminar la transacción.

PF3 para ir al menú inicial de la transacción OO34.

PF7 aparecerán las operaciones anteriormente consultadas.

PF8 aparecerán las siguientes operaciones a consultar.

2.6.3. Saldos disponibles.

Seleccionando la opción 2 del menú de consultas en tiempo real, se accederá a la consulta de los saldos disponibles.

Utilizando esta consulta se puede conocer el saldo disponible de una referencia dada en cada una de sus carteras en cualquier momento.

CATM342 – Saldos disponibles.

```
0034.2   CAT-CENTRAL DE ANOTACIONES - SALDOS DISPONIBLES
                                                    IMPORTES EN EUROS
                                          FECHA OPERACION:

  SELECCIONE ENTIDAD:
             CODIGO VALOR:  __________


  - CUENTA PROPIA LIBRE .......:

  - CUENTA TERCEROS LIBRE .....:

  - CUENTA PROPIA BLOQUEADA ...:

  - CUENTA TERCEROS BLOQUEADA .:




  PF2: FIN   PF3: MENU ANT.
```

El contenido y significado de los campos de esta pantalla es el siguiente:

* FECHA OPERACIÓN:

Fecha de valor sobre la que se realiza la consulta, en formato DDMMAAAA.
Esta fecha es la fecha de proceso del Sistema CAT.
Campo no modificable.

* ENTIDAD:

Campo en el cual se indica la entidad cuyos saldos se desean consultar. Sólo se podrán consultar los datos de la propia entidad o de aquellas a las que se esté autorizada.
Campo modificable.

* CODIGO DE VALOR:

Campo en el cual se indica el Código de Valor cuyo saldo se desea conocer.
Campo modificable.

* CUENTA PROPIA LIBRE:

Campo en el cual se muestra el saldo libre disponible para la cuenta propia de la entidad para el código de valor tecleado en el momento de la consulta. Este saldo no tiene en cuenta los compromisos futuros de manera que la entidad puede estar en descubierto futuro para una operación y en la consulta no está reflejado.

* CUENTA TERCEROS LIBRE:

Campo en el cual se muestra el saldo libre disponible para la cuenta de terceros de la entidad para el código de valor tecleado en el momento de la consulta. Este saldo no tiene en cuenta los compromisos futuros de manera que la entidad puede estar en descubierto futuro para una operación y en la consulta no está reflejado.

* CUENTA PROPIA BLOQ:

Campo en el cual se muestra el saldo bloqueado disponible para la cuenta propia de la entidad para el código de valor tecleado en el momento de la consulta. Este saldo no tiene en cuenta los compromisos futuros de manera que la entidad puede estar en descubierto futuro para una operación y en la consulta no está reflejado.

* CUENTA TERCEROS BLOQ:

Campo en el cual se muestra el saldo bloqueado disponible para la cuenta de terceros de la entidad para el código de valor tecleado en el momento de la consulta. Este saldo no tiene en cuenta los compromisos futuros de manera que la entidad puede estar en descubierto futuro para una operación y en la consulta no está reflejado.

Al rellenar los datos de consulta obligatorios y pulsando **INTRO**, se realiza la consulta por pantalla de los saldos disponibles en tiempo real.

Otras teclas de función activas son:

PF2 para terminar la transacción.

PF3 para volver al menú principal.